

금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 시행세칙 <별지 제67호>에 따라 고난도 집합투자증권 지정과 관련한 파생상품 위험평가액 산정시 일정거래를 제외하는 집합투자기구의 파생상품 위험평가액을 다음과 같이 공시합니다

1. 계산방법 : 금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 시행세칙 <별지 제67호> 제2-1조 2호, 제3-1조 및 제4-1조에 의하여 계산

2. 집합투자기구명 : 신한에쿼티알파일반사모혼합자산

3. 고난도 집합투자증권 산정관련 파생상품 위험평가액(2024.05.09기준)

| 1) 파생상품종류        | 주가지수선물                  |                          |
|------------------|-------------------------|--------------------------|
| 2) 종목명           | 2024-06 대한항공개별선물 (매도)   | 2024-06 코스피200지수선물 (매도)  |
|                  | 2024-06 한화솔루션개별선물 (매도)  |                          |
|                  | 2024-06 HD현대미포개별선물 (매도) | 2024-05 미니코스피200 선물 (매도) |
| 3) 포지션           | 매도                      |                          |
| 4) 파생상품 위험평가액*   | 0                       |                          |
| 5) NAV           | 2,017,036,623           |                          |
| 6) 파생위험평가액/NAV** | 0%                      |                          |

4. 기타 : 2024-06 대한항공개별선물 (매도), 2024-06 한화솔루션개별선물 (매도), 2024-06 HD현대미포개별선물 (매도) / 신규거래

2024-05 하나금융지주개별선물 (매도), 2024-05 LG디스플레이개별선물 (매도), 2024-05 KB금융개별선물 (매도), 2024-05 GS건설개별선물 (매도), 2024-05 LG생활건강개별선물 (매도), 2024-05 카카오게임즈개별선물 (매도), 2024-05 펄어비스개별선물 (매도), 금양 F 202405 ( 10) (매수) / 청산

\* 이 공시는 고난도 금융투자상품에서 제외되는 파생상품관련이며, 자본시장법 및 집합투자규약등에서 제한하는 파생상품 위험평가액과는 다를수 있음(별표\*\*참조)

\*\* 현재, 자본시장법 및 집합투자규약 관련 파생상품 위험평가액 비율은 약 23.58% 입니다.